



Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020





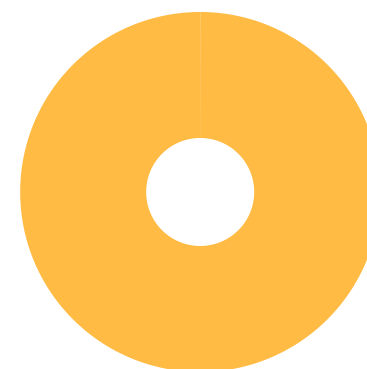
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	101.065,05	100,00%	1.225	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			101.065,05				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			335.560,44				Artigo 6º
PL Total			436.625,49				



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	101.065,05
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	101.065,05	100,00%	40,00%	75,00%	100,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	101.065,05
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.053,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	60.639,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	60.639,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	12,00%	40,00%	40.426,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	40.426,02
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	20.213,01
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	15.159,76
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	15.159,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.053,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	5.053,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.053,25
Total Renda Fixa	100,00%	101.065,05	100,00%	40,00%	92,00%	570,00%	



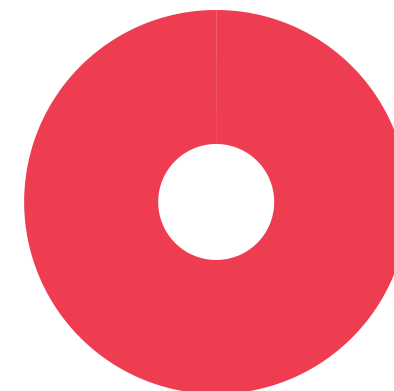
RENDA FIXA 101.065,05



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	30.319,52
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	30.319,52
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	20.213,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	20.213,01
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	10.106,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.053,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.053,25
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	8,00%	120,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	10.106,51
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	10.106,51
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	10.106,51
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	



7º I b

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 70977016-cd42-443c-ba5b-5093eae7bfds



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	101.065,05	100,00	0,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	101.065,05	100,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	6,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	4,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	7,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Documento Assinado Digitalmente por: CLEA RIBEIRO OLIVEIRA
 Acesse em: https://www.tcece.tcece.gov.br/dep/validador/validador.asp?doc=20200927016445445c1a5b2092ae70d15



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	3,47%	0,63%	0,99%	3,47%	10,19%	0,10%	0,01%

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
 Acesse em: <https://etec.ice.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 70977016-cd42-443c-ba5b-5093eae7bf15



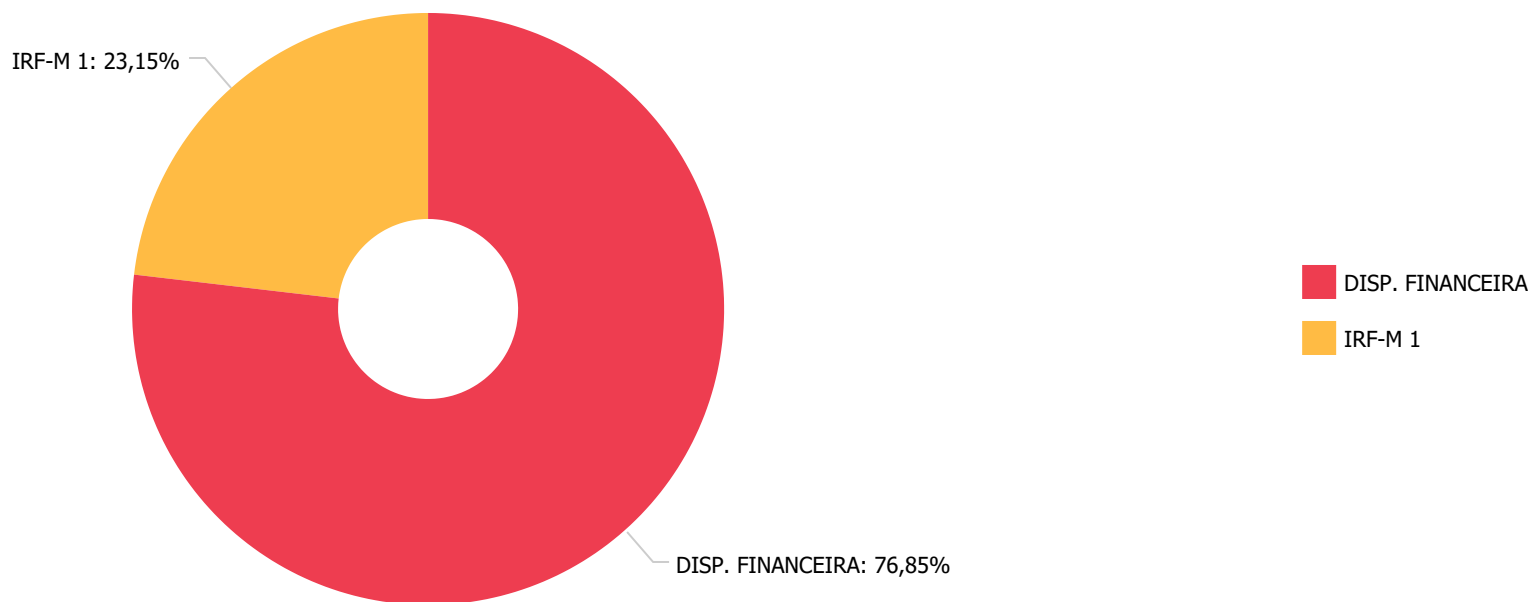
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2020)



Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 70977016-cd42-443c-ba5d-5093eae7bf15



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



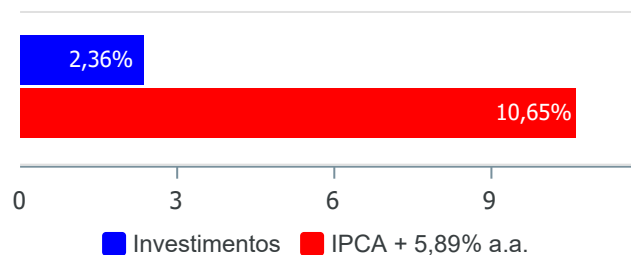
Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etce.tce.pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do Documento: 70977016-cd42-443c-ba5b-5093eae7bf15



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	V
Janeiro	17.269,16	0,00	0,00	17.341,58	72,42	72,42	0,42%	0,42%	0,71%	0,71%	58,90%	0,00%
Fevereiro	17.341,58	90.000,00	0,00	107.545,44	203,86	276,28	0,19%	0,61%	0,66%	1,38%	44,30%	0,00%
Março	107.545,44	1.042,85	108.042,98	687,48	142,17	418,45	0,13%	0,74%	0,57%	1,96%	37,92%	0,00%
Abril	687,48	0,00	0,00	690,32	2,84	421,29	0,41%	1,16%	0,14%	2,10%	55,06%	0,00%
Mai	690,32	0,00	0,00	693,00	2,68	423,97	0,39%	1,55%	0,07%	2,18%	71,19%	0,00%
Junho	693,00	0,00	0,00	694,78	1,78	425,75	0,26%	1,81%	0,74%	2,93%	61,75%	0,00%
Julho	694,78	170.000,00	170.000,00	654,38	-40,40	385,35	-0,02%	1,79%	0,89%	3,85%	46,49%	0,00%
Agosto	654,38	1.037.484,70	1.037.491,35	654,95	7,22	392,57	0,00%	1,79%	0,72%	4,59%	38,94%	0,00%
Setembro	654,95	0,00	0,00	655,23	0,28	392,85	0,04%	1,83%	1,12%	5,76%	31,77%	0,00%
Outubro	655,23	0,00	0,00	655,98	0,75	393,60	0,11%	1,95%	1,34%	7,18%	27,12%	0,00%
Novembro	655,98	100.000,00	0,00	100.749,76	93,78	487,38	0,09%	2,04%	1,35%	8,63%	23,67%	0,00%
Dezembro	100.749,76	0,00	0,00	101.065,05	315,29	802,67	0,31%	2,36%	1,86%	10,65%	22,19%	0,00%

Investimentos x Meta Atuarial

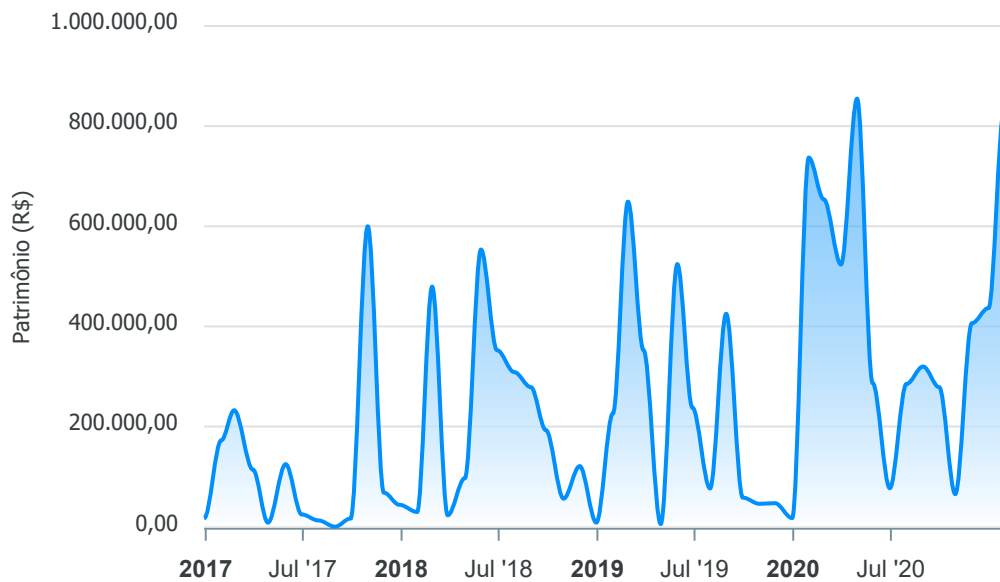


Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: https://cgc.fcp.br/portal/verificador-credencial-coordenador-de-documentos/7097016-cd42-443c-ba5d-5093eae7bf15



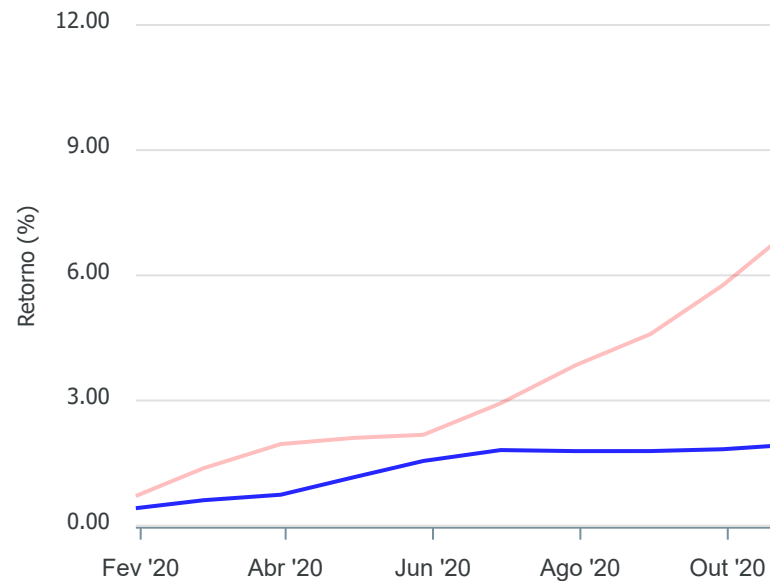
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Acesse em: <https://etce.tce-pe.gov.br/epp/validaDoc.seam> Código do documento: 70977016-cd42-443c-ba5b-5093eae7b1d5



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	100.749,76	0,00	0,00	101.065,05	315,29	0,31%	0,31%	0,10
Total Renda Fixa	100.749,76	0,00	0,00	101.065,05	315,29	0,31%		0,10

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Assinse em: https://sccs.tcepe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 70977016-cd42-443c-ba5b-5093eae7bf1d5



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Inicial
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	655,23	100.000,00	0,00	101.065,05	409,82	0,41%	0,63%
				Total Renda Fixa	409,82	0,41%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Assinse em: https://sccs.ce.gov.br/epp/validaDoc:seam Código do documento: 70977016-cd42-443c-ba5b-5093eae7bf15



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Int.
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	17.269,16	360.000,00	277.000,00	101.065,05	795,89	0,21%	3,47%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	0,00	1.038.527,55	1.038.534,33	0,00	6,78	0,00%	0,49%
Total Renda Fixa					802,67	0,80%	

Documento Assinado Digitalmente por: CLECIA RIBEIRO DIAS BEZERRA
Assinse em: https://sccs.tcepe.gov.br/epp/validaDoc.seam Código do documento: 70977016-cd42-443c-ba5b-5093eae7bfds